



UNIVERSITA' DEGLI STUDI DI PISA
Facoltà di Economia

Corso di Laurea Specialistica in Scienze Economiche

Tesi di Laurea

Calcolo di Malliavin per la valutazione delle *Greche*:
un approccio Monte Carlo

Relatore:

Chiar.mo Prof. Carlo Bianchi

Correlatore:

Chiar.ma Prof.ssa Maria Elvira Mancino

Candidato:

Flavia Barsotti

Anno Accademico 2006-2007
Sessione di Laurea Ottobre 2007